

DAFTAR ISI

Halaman Judul.....	i
Halaman Persetujuan Pembimbing	ii
Halaman Pengesahan	iii
Halaman Motto dan Persembahan	iv
Pernyataan Keaslian Karya Tulis Skripsi.....	v
Pernyataan Persetujuan Unggah Karya Tulis Skripsi	vi
Abstraksi	vii
Abstract	viii
Kata Pengantar	ix
Daftar Isi.....	xii
Daftar Gambar.....	xv
Daftar Tabel	xvi
Daftar Lampiran	xviii

BAB I PENDAHULUAN

A. Latar Belakang	1
B. Rumusan Masalah	7

C. Tujuan Penelitian	8
D. Manfaat Penelitian	9
E. Sistematika Penulisan	10

BAB II LANDASAN TEORI

A. Teori Pasar Efisien	12
B. Saham	13
C. Return Saham	14
D. Anomali Pasar	16
E. Size Effect	18
F. Ukuran Perusahaan	19
G. Kapitalisasi Pasar	20
H. Aset	21
I. Penelitian Terdahulu	22
J. Pengembangan Hipotesis	23

BAB III METODOLOGI PENELITIAN

A. Jenis Penelitian	26
B. Populasi dan Sampel	26
C. Jenis dan Sumber Data Penelitian	27
D. Variabel dan Pengukurannya	28
E. Teknik Analisa Data	29

BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN

A. Populasi dan Sampel	31
B. Statistik Deskriptif	32
C. Uji Normalitas	35
D. Uji Hipotesis	37
E. Pembahasan.....	42
F. Implikasi.....	43

BAB V SIMPULAN, KETERBATASAN, DAN SARAN

A. Simpulan	44
B. Keterbatasan.....	44
C. Saran.....	45

Daftar Pustaka

Lampiran

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1	Perkembangan IHSG.....	5
------------	------------------------	---

DAFTAR TABEL

Tabel 1.1	Rata-Rata Keseluruhan Return Perusahaan Berukuran Besar dan Kecil Berdasarkan Kapitalisasi Pasar Tahun 2012-2016	4
Tabel 1.2	Rata-Rata Keseluruhan Return Perusahaan Berukuran Besar dan Kecil Berdasarkan Total Aset Tahun 2012-2016	4
Tabel 2.1	Jenis-jenis Anomali Pasar	17
Tabel 4.1	Data Sampel Kapitalisasi Pasar	31
Tabel 4.2	Data Sampel Total Aset	32
Tabel 4.3	Hasil Statistik Deskriptif <i>Return</i> Perusahaan	32
Tabel 4.4	Hasil Uji Normalitas <i>Return</i> Perusahaan Berdasarkan Kapitalisasi Pasar	35
Tabel 4.5	Hasil Uji Normalitas <i>Return</i> Perusahaan Berdasarkan Kapitalisasi Pasar Periode <i>Bullish</i>	35
Tabel 4.6	Hasil Uji Normalitas <i>Return</i> Perusahaan Berdasarkan Kapitalisasi Pasar Periode <i>Bearish</i>	36
Tabel 4.7	Hasil Uji Normalitas <i>Return</i> Perusahaan Berdasarkan Total Aset	36
Tabel 4.8	Hasil Uji Normalitas <i>Return</i> Perusahaan Berdasarkan Total Aset Periode <i>Bullish</i>	36
Tabel 4.9	Hasil Uji Normalitas <i>Return</i> Perusahaan Berdasarkan Total Aset Periode <i>Bearish</i>	37
Tabel 4.10	Uji Independent Sample t Test <i>Return</i> Perusahaan Berdasarkan Kapitalisasi Pasar	37

Tabel 4.11	Uji Independent Sample t Test <i>Return</i> Perusahaan Berdasarkan Total Aset	38
Tabel 4.12	Uji Independent Sample t Test <i>Return</i> Perusahaan Berdasarkan Kapitalisasi Pasar Periode <i>Bullish</i>	39
Tabel 4.13	Uji Independent Sample t Test <i>Return</i> Perusahaan Berdasarkan Kapitalisasi Pasar Periode <i>Bearish</i>	39
Tabel 4.14	Uji Independent Sample t Test <i>Return</i> Perusahaan Berdasarkan Total Aset <i>Bullish</i>	40
Tabel 4.15	Uji Independent Sample t Test <i>Return</i> Perusahaan Berdasarkan Total Aset <i>Bearish</i>	41

DAFTAR LAMPIRAN

- Lampiran 1 Penelitian Terdahulu
- Lampiran 2 Uji Statistik Deskriptif
- Lampiran 3 Uji Normalitas
- Lampiran 4 Pengujian Hipotesis
- Lampiran 5 Data Sampel
- Lampiran 6 Kartu Bimbingan